

# 中泰星元价值优选灵活配置混合型证券投资基金

## 2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人:中泰证券(上海)资产管理有限公司

基金托管人:宁波银行股份有限公司

送出日期:2022 年 08 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告由董事长签发。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年8月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年1月1日起至6月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	22
§7 投资组合报告	51
7.1 期末基金资产组合情况	51
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	51
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	52
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	57
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	57
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	57
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
7.12 投资组合报告附注	57
§8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	59

§9 开放式基金份额变动.....	59
§10 重大事件揭示.....	60
10.1 基金份额持有人大会决议.....	60
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	60
10.4 基金投资策略的改变.....	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60
10.8 其他重大事件.....	61
§11 备查文件目录.....	64
11.1 备查文件目录.....	64
11.2 存放地点.....	65
11.3 查阅方式.....	65

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中泰星元价值优选灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	中泰星元灵活配置混合	
基金主代码	006567	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年12月05日	
基金管理人	中泰证券（上海）资产管理有限公司	
基金托管人	宁波银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,456,030,304.43份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中泰星元灵活配置混合A	中泰星元灵活配置混合C
下属分级基金的交易代码	006567	012940
报告期末下属分级基金的份额总额	1,496,370,235.12份	959,660,069.31份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过紧密跟踪中国经济发展方向和周期变动特征，挖掘各个行业具有领先指标和发展潜力的上市公司，分享中国经济持续快速增长的成果，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	基金管理人主要采取自下而上的选股策略，通过财务数据的定量分析筛选可选标的以提升选股效率，再通过对企业核心竞争力、竞争格局、竞争优势、盈利模式等定性分析精选个股，深入研究、多方验证、持续跟踪，力争在控制风险的前提下获得可观收益。在选择个股时，主要关注两类标的，一是估值具有足够安全边际、竞争优势明确的白马股，二是估值合理具有明确成长性的成长股。
业绩比较基准	中证800指数收益率*60%+中债综合指数收益率*40%
风险收益特征	本基金是混合型基金，属于较高预期风险、较高

	预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。
--	---

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中泰证券（上海）资产管理有限公司	宁波银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王洪懿	朱广科
	联系电话	021-20521199	0574-87050338
	电子邮箱	wanghy@ztzqzg.com	custody-audit@nbc.cn
客户服务电话		400-821-0808	0574-83895886
传真		021-50933716	0574-89103213
注册地址		上海市黄浦区延安东路175号24楼05室	中国浙江宁波市鄞州区宁东路345号
办公地址		上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1002-1003室	中国浙江宁波市鄞州区宁东路345号
邮政编码		200120	315100
法定代表人		黄文卿	陆华裕

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ztzqzg.com
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1002-1003室

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中泰证券（上海）资产管理有限公司	上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1002-1003室

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2022年01月01日-2022年06月30日)	
	中泰星元灵活配置 混合A	中泰星元灵活配置 混合C
本期已实现收益	109,711,893.29	77,591,392.94
本期利润	211,645,538.95	106,585,727.46
加权平均基金份额本期利润	0.1895	0.1369
本期加权平均净值利润率	7.93%	5.72%
本期基金份额净值增长率	7.48%	7.29%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)	
期末可供分配利润	1,879,421,285.12	1,197,265,480.32
期末可供分配基金份额利润	1.2560	1.2476
期末基金资产净值	3,720,003,196.39	2,377,343,032.26
期末基金份额净值	2.4860	2.4773
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	148.60%	22.69%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

## 3.2 基金净值表现

## 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中泰星元灵活配置混合A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	2.60%	0.87%	5.24%	0.63%	-2.64%	0.24%
过去三个月	4.05%	1.26%	3.37%	0.88%	0.68%	0.38%
过去六个月	7.48%	1.27%	-5.68%	0.88%	13.16%	0.39%
过去一年	24.30%	1.11%	-6.41%	0.73%	30.71%	0.38%
过去三年	126.45%	1.10%	14.83%	0.75%	111.62%	0.35%
自基金合同 生效起至今	148.60%	1.10%	25.82%	0.77%	122.78%	0.33%

## 中泰星元灵活配置混合C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	2.57%	0.87%	5.24%	0.63%	-2.67%	0.24%
过去三个月	3.95%	1.26%	3.37%	0.88%	0.58%	0.38%
过去六个月	7.29%	1.27%	-5.68%	0.88%	12.97%	0.39%
自基金合同 生效起至今	22.69%	1.13%	-5.76%	0.74%	28.45%	0.39%

注：

本基金自 2021 年 7 月 19 日起增设 C 类基金份额。上表中 C 类基金份额净值表现相关数据均为 2021 年 7 月 19 日以来的数据。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



中泰星元灵活配置混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2018年12月05日-2022年06月30日)



中泰星元灵活配置混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年07月19日-2022年06月30日)



注：本基金自 2021 年 7 月 19 日起增设 C 类份额。

#### § 4 管理人报告

## 4.1 基金管理人及基金经理情况

### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中泰证券（上海）资产管理有限公司成立于2014年8月13日。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准齐鲁证券有限公司设立资产管理子公司的批复》（证监许可[2014]355号）批准，是齐鲁证券有限公司（现已更名为“中泰证券股份有限公司”）出资设立的证券资产管理子公司。2017年12月，根据中国证券监督管理委员会《关于核准中泰证券（上海）资产管理有限公司公开募集证券投资基金管理业务资格的批复》（证监许可[2017]2342号）批准，公司获得开展公募基金业务资格。目前公司主要业务为证券资产管理业务和公开募集证券投资基金业务。截至2022年6月30日，公司作为基金管理人共管理中泰星元价值优选灵活配置混合型证券投资基金、中泰玉衡价值优选灵活配置混合型证券投资基金、中泰蓝月短债债券型证券投资基金、中泰开阳价值优选灵活配置混合型证券投资基金、中泰青月中短债债券型证券投资基金、中泰中证500指数增强型证券投资基金、中泰沪深300指数增强型证券投资基金、中泰青月安盈66个月定期开放债券型证券投资基金、中泰兴诚价值一年持有期混合型证券投资基金、中泰星宇价值成长混合型证券投资基金、中泰稳固周周购12周滚动持有债券型证券投资基金、中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金、中泰安睿债券型证券投资基金、中泰安益利率债债券型证券投资基金、中泰锦泉汇金货币市场基金、中泰兴为价值精选混合型证券投资基金、中泰红利价值一年持有期混合型发起式证券投资基金、中泰红利优选一年持有期混合型发起式证券投资基金共十八只证券投资基金。

### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
姜诚	本基金基金经理；中泰玉衡价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理；中泰兴诚价值一年持有期混合型证券投资基金基金经理；中泰兴为价值精选混合型证券投资基金基金经理；中泰红利价值	2018-12-05	-	16	国籍：中国。学历：上海财经大学经济学硕士研究生。具备证券从业资格和基金从业资格。曾任安信基金管理有限责任公司研究部副总经理、基金投资部总经理；国泰君安证券股份有限公司资产管理总

	<p>一年持有期混合型发起式证券投资基金基金经理；中泰红利优选一年持有期混合型发起式证券投资基金基金经理；基金业务部总经理。</p>			<p>部研究员、投资经理；2016年4月加入中泰证券（上海）资产管理有限公司任基金业务部总经理。2018年12月5日起至今担任中泰星元价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019年3月20日起至今担任中泰玉衡价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2019年9月6日至2021年3月22日期间担任中泰开阳价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2021年2月8日起至今担任中泰兴诚价值一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2022年1月18日起至今担任中泰兴为价值精选混合型证券投资基金基金经理。2022年3月24日起至今担任中泰红利价值一年持有期混合型发起式证券投资基金和中泰红利优选一年持有期混合型发起式证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	---

注：1、首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，非首任基金经理的“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期，基金经理的“离任日期”均为根据公司决定确定的解聘日期；

2、证券从业年限的计算标准及含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，各项公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行，未出现违反制度的情况。

本报告期内，我司旗下产品所有投资品种的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节均严格执行《中泰证券（上海）资产管理有限公司公平交易及异常交易制度》。

公司建立了针对公平交易进行事前控制、事中监控、事后分析的完整流程，形成有效的公平交易体系。

事前控制包括：通过建立投资研究沟通机制确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策等方面享有公平的机会；对各投资组合的重大非公开投资信息进行相互隔离；并通过投资交易系统进行公平交易和反向交易风控设置。

事中监控通过执行集中交易制度，将投资管理与交易执行相分离，交易由交易部集中执行。交易部以公平交易为原则，保证投资组合的交易得到公平、及时、准确、高效地执行，确保不同产品享有公平的交易执行机会；对不同账户的交易指令按照“时间优先、价格优先”原则执行；同时接收的交易指令在分配和执行过程中，避免因投资组合资产的大小、成交额的大小及交易难易等客观因素或个人主观好恶而出现执行时间及执行数量比例的明显不均现象；同时收到不同投资组合账户同种证券同向买卖指令时，避免交易因执行的时间、比例明显不同而出现交易均价明显差异的现象。

事后分析主要集中在对不同投资组合同日或者临近交易日同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，监督检验公平交易原则实施情况，识别是否存在不公平交易和任何利益输送嫌疑的交易行为。

1、同向交易价差分析，主要是通过分析产品间不同时间窗口（1日、3日、5日）的同向交易价差，来分析判断同向交易是否存在违反公平交易原则和利益输送的行为，分析判断的方法和指标包括同向交易价差T检验、差价率均值、占优比率、差价贡献率等。

2、反向交易分析，主要通过分析产品不同时间窗口（同日、隔日、3日、5日）反向交易成交较少的单边交易量占相关证券当日成交量情况的分析，识别是否存在任何利益输送嫌疑的交易行为。

本报告期内，公平交易分析基本结论如下：

- 1、报告期内不存在产品间同向交易行为导致利益输送的结果；
- 2、报告期内不存在产品间反向交易行为导致利益输送的结果。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

异常交易，是指本公司所管理的各产品自身或产品之间所发生的交易对象、交易时间、交易价格、交易数量和交易理由等单项或多项出现异常。公司管理产品买卖法规、产品管理合同、交易制度等限制投资对象的交易均认定为交易对象异常型异常交易。公司管理的产品进行沪深京交易所股票场内竞价交易时，如果产品单独或共同在收盘前15分钟的单边交易量占该品种当日场内竞价交易总量比例超过15%，则认定为交易时间异常型异常交易。产品在连续竞价阶段委托价格超过最新价格的3%，则作为交易价格异常型异常交易。公司管理的产品进行沪深京交易所股票场内竞价交易时，如果产品单独或共同在交易当日的单边交易量占该品种当日场内竞价交易总量比例超过30%，即作为交易数量异常型异常交易。内幕交易，频繁申报与撤单，不能列示有充分投资研究成果支持的交易，以及投资管理人员受他人干预，未能就投资、交易等事项做出客观、公正的独立判断与决策的交易，均作为交易理由异常型异常交易。

风险管理部通过系统或人工手段，监控各产品的异常交易，如果发现某笔交易符合异常交易界定标准，将其列为异常交易，并建立异常交易档案，系统记录异常交易发生的时间、具体交易情况及认定人和认定依据，对于风险管理部识别出的异常交易，要求基金经理（投资主办）进行合理解释，并提交书面说明至风险管理部备案。

本报告期内，发生交易数量异常型异常交易，但是未对股票价格造成显著影响。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年市场波动较大，一季度剧烈下跌，二季度大幅反弹，在这一过程中，价值型股票表现相对稳定，成长型股票波动更加剧烈。而我们一直以长期视角看问题，并希望股票的价格提供足够保护，结合市场提供的估值水平，与多数同行相比在价值型股票中配置更多，所以显得相对平稳，虽然也并没有什么出色战绩。

市场为何会如此波动剧烈？根源或许是投资者整体性的焦虑。焦虑的点在哪里？源自对“效率”的极致追求。效率如何体现？最好是买入即涨，卖出即跌。如何做到买入即涨，卖出即跌？需要在边际信息追逐赛中占先。有哪些边际信息需要关注？不一而足，包括但不限于：货币政策动向，稳增长政策预期及落地效果，疫情的反复，国际资本流动，还有永不缺席的基本面“景气度”。

正因为影响因素多，就产生了一种迷惑性现象，即我们很容易做后见之明的事后诸葛亮，却很难当先见之明的预言家。比如，2018年基本面的大底，构成了成长股2019和2020年气势如虹的上涨基础；疲弱的宏观表现让消费股在2021年承压；而电动车销售的

持续井喷保障了新能源板块的一骑绝尘；供给端的出清也让资源品走出了结构性牛市……头头是道的解读，没有一点点指导意义，因为决定未来涨跌的信息还在未来，并且不止取决于上述因素会如何演绎，还取决于当前市场价格中反映的市场预期。所以，猜测市场先生将要出啥牌，实际上是高阶博弈，进而内卷，“钱景”也就变得高度不确定。

我们很早就放弃了择时，任凭净值在市场波诡云谲中涨跌，而专注于提高长期赚钱的概率。这一投资框架有些剑走偏锋，但很好用——不争胜，更难败；愿意忍受波动，也未必大波动。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中泰星元灵活配置混合A基金份额净值为2.4860元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为7.48%，同期业绩比较基准收益率为-5.68%；截至报告期末中泰星元灵活配置混合C基金份额净值为2.4773元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为7.29%，同期业绩比较基准收益率为-5.68%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

立足当下，展望未来，抛开短期预测不谈，从长期看我们依然乐观：一是对中国经济前景乐观，波动在所难免，体量大了长期潜在增长率也会下降，但存量经济下更容易形成好的产业格局，好的产业格局带来更好的资本回报，巨大的内需市场和全球比较优势给优秀企业提供广阔的表演舞台，看空国运者是杞人忧天；二是对组合当下的状态乐观，在安全边际思想指引下，我们一直习惯于发下等愿，重仓一只股票的前提是能容忍它的缺点而不是无限放大它的优点，没有太多可失去的，不确定性就关乎能得到多少。

不贪心，就无需用百米冲刺的节奏去跑一场马拉松。所以，下半年行情会如何演绎，一点都不重要；下半年如何规划投资，也根本不是问题。下半年我们要做啥，不是现在能规划的，取决于彼时的市场状况，我们笃信：市场只能应对，不能预测。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、基金合同以及中国基金业协会提供的相关估值指引对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由基金管理人与基金托管人分别独立完成。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额的份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

基金管理人设立了估值委员会，由公司总经理、主管基金运营的公司高管、合规负责人及投资管理、风险管理、基金运营等方面的专业人员担任委员。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。估值委员会对经济环境发生重大

变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件进行评估，充分听取相关部门的建议，并和托管人充分协商后，形成估值委员会决议。运营部按照批准后的估值政策进行估值。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本托管人在中泰星元价值优选灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：“财务会计报告”中的“各关联方投资本基金的情况”、“金融工具风险及管理”部分以及“基金份额持有人信息”部分均未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：中泰星元价值优选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	795,499,910.11	106,255,541.95
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	5,366,963,582.19	1,099,580,996.83
其中：股票投资		5,366,963,582.19	1,099,580,996.83
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	180,100,450.25
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		35,285,680.51	3,524,045.98
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-35,068.81
资产总计		6,197,749,172.81	1,389,425,966.20
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>



		2022年06月30日	2021年12月31日
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		90,566,375.06	1,956,680.07
应付管理人报酬		7,965,992.64	1,591,286.21
应付托管费		531,066.17	106,085.75
应付销售服务费		914,900.31	37,484.73
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	7,318.07
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	424,609.98	301,461.76
负债合计		100,402,944.16	4,000,316.59
<b>净 资 产：</b>			
实收基金	6.4.7.6	2,456,030,304.43	599,103,863.06
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.7	3,641,315,924.22	786,321,786.55
净资产合计		6,097,346,228.65	1,385,425,649.61
负债和净资产总计		6,197,749,172.81	1,389,425,966.20

注：报告截止日2022年6月30日，基金份额总额2,456,030,304.43份，其中A类份额1,496,370,235.12份，C类份额959,660,069.31份。A类份额净值2.4860元，C类份额净值2.4773元。

## 6.2 利润表

会计主体：中泰星元价值优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至202 1年06月30日
一、营业总收入		357,566,797.65	50,976,390.46
1. 利息收入		3,846,021.86	514,636.78
其中：存款利息收入	6.4.7.8	2,587,257.15	283,346.49
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,258,764.71	231,290.29
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		217,653,012.24	48,135,895.43
其中：股票投资收益	6.4.7.9	113,440,749.30	42,077,445.76
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.10	-	-
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.11	-	-
股利收益	6.4.7.12	104,212,262.94	6,058,449.67
以摊余成本计量的 金融资产终止确认 产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.13	130,927,980.18	2,067,442.31
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.14	5,139,783.37	258,415.94

<b>减：二、营业总支出</b>		39,335,531.24	4,292,296.87
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	33,345,990.80	3,574,405.10
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,223,066.06	238,293.71
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	3,652,846.89	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		4,531.55	832.64
8. 其他费用	6.4.7.15	109,095.94	478,765.42
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		318,231,266.41	46,684,093.59
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		318,231,266.41	46,684,093.59
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		318,231,266.41	46,684,093.59

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中泰星元价值优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	599,103,863.06	-	786,321,786.55	1,385,425,649.61

产（基金净值）				
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	599,103,863.06	-	786,321,786.55	1,385,425,649.61
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,856,926,441.37	-	2,854,994,137.67	4,711,920,579.04
（一）、综合收益总额	-	-	318,231,266.41	318,231,266.41
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,856,926,441.37	-	2,536,762,871.26	4,393,689,312.63
其中：1. 基金申购款	3,183,289,614.05	-	4,389,940,720.06	7,573,230,334.11
2. 基金赎回款	-1,326,363,172.68	-	-1,853,177,848.80	-3,179,541,021.48
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	2,456,030,304.43	-	3,641,315,924.22	6,097,346,228.65
项 目	上年度可比期间			

	2021年01月01日至2021年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	202,615,172.83	-	161,226,055.12	363,841,227.95
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	202,615,172.83	-	161,226,055.12	363,841,227.95
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	95,574,422.27	-	136,968,720.62	232,543,142.89
（一）、综合收益总额	-	-	46,684,093.59	46,684,093.59
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	95,574,422.27	-	90,284,627.03	185,859,049.30
其中：1. 基金申购款	141,754,704.54	-	132,582,019.04	274,336,723.58
2. 基金赎回款	-46,180,282.27	-	-42,297,392.01	-88,477,674.28
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收	-	-	-	-

益				
四、本期期末净资产（基金净值）	298,189,595.10	-	298,194,775.74	596,384,370.84

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

黄文卿

应晨奇

陈勇

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中泰星元价值优选灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]1636号《关于准予中泰星元价值优选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》注册,由中泰证券(上海)资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中泰星元价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币956,646,453.14元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第0694号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中泰星元价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2018年12月5日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为956,804,364.70份基金份额,其中认购资金利息折合157,911.56份基金份额。本基金的基金管理人为中泰证券(上海)资产管理有限公司,基金托管人为宁波银行股份有限公司。

根据《关于中泰星元价值优选灵活配置混合型证券投资基金增设C类基金份额并相应修订法律文件的公告》,自2021年7月19日,本基金增加C类基金份额,原份额转为A类基金份额。在投资者申购时收取申购费,赎回时根据持有期限收取赎回费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;在投资者申购时不收取申购费,赎回时根据持有期限收取赎回费用,且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类、C类两种收费模式并存,本基金A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中泰星元价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准发行的股票)、债券(含国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可

转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、次级债以及中国证监会允许投资的其它债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为0%-95%;本基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中证800指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%。

本财务报表由本基金的基金管理人中泰证券(上海)资产管理有限公司于2022年8月29日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中泰星元价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2022年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2022年6月30日的财务状况以及2022年上半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。除下述会计政策外,本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

##### 6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

#### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

#### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

#### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对



金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### 新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

### 新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

原金融工具准则（截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则）

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》及《企业会计准则第37号—金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于2022年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年上半年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

#### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、买入返售金融资产、应收利息和应收申购款，金额分别为 106,255,541.95 元、180,100,450.25 元、-35,068.81 元和 3,524,045.98 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、买入返售金融资产、其他资产-应收利息和应收申购款，金额分别为 106,306,918.74 元、180,014,004.65 元、0.00 元和 3,524,045.98 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 1,099,580,996.83 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 1,099,580,996.83 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债-其他应付款，金额分别为 1,956,680.07 元、1,591,286.21 元、106,085.75 元、37,484.73 元和 1,461.76 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债-其他应付款，金额分别为 1,956,680.07 元、1,591,286.21 元、106,085.75 元、37,484.73 元和 1,461.76 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

#### (b) 修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

## 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2022年06月30日	
活期存款	110,879,170.80	
等于：本金	110,822,612.37	
加：应计利息	56,558.43	
减：坏账准备	-	
定期存款	-	
等于：本金	-	
加：应计利息	-	
减：坏账准备	-	
其中：存款期限1个月以内	-	
存款期限1-3个月	-	
存款期限3个月以上	-	
其他存款	684,620,739.31	
等于：本金	684,463,684.24	
加：应计利息	157,055.07	
减：坏账准备	-	
合计	795,499,910.11	

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2022年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	5,157,731,181.11	-	5,366,963,582.19	209,232,401.08
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		5,157,731,181.11	-	5,366,963,582.19	209,232,401.08

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末各项买入返售金融资产无余额。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	75,454.38
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	349,095.94

其他应付	59.66
合计	424,609.98

#### 6.4.7.6 实收基金

##### 6.4.7.6.1 中泰星元灵活配置混合A

金额单位：人民币元

项目 (中泰星元灵活配置混合A)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	541,751,532.74	541,751,532.74
本期申购	1,377,637,145.11	1,377,637,145.11
本期赎回(以“-”号填列)	-423,018,442.73	-423,018,442.73
本期末	1,496,370,235.12	1,496,370,235.12

##### 6.4.7.6.2 中泰星元灵活配置混合C

金额单位：人民币元

项目 (中泰星元灵活配置混合C)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	57,352,330.32	57,352,330.32
本期申购	1,805,652,468.94	1,805,652,468.94
本期赎回(以“-”号填列)	-903,344,729.95	-903,344,729.95
本期末	959,660,069.31	959,660,069.31

#### 6.4.7.7 未分配利润

##### 6.4.7.7.1 中泰星元灵活配置混合A

单位：人民币元

项目 (中泰星元灵活配置混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	637,984,746.88	73,260,511.49	711,245,258.37
本期利润	109,711,893.29	101,933,645.66	211,645,538.95



本期基金份额交易产生的变动数	1,131,724,644.95	169,017,519.00	1,300,742,163.95
其中：基金申购款	1,644,428,802.40	244,994,340.28	1,889,423,142.68
基金赎回款	-512,704,157.45	-75,976,821.28	-588,680,978.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,879,421,285.12	344,211,676.15	2,223,632,961.27

## 6.4.7.7.2 中泰星元灵活配置混合C

单位：人民币元

项目 (中泰星元灵活配置混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	67,327,066.10	7,749,462.08	75,076,528.18
本期利润	77,591,392.94	28,994,334.52	106,585,727.46
本期基金份额交易产生的变动数	1,052,347,021.28	183,673,686.03	1,236,020,707.31
其中：基金申购款	2,142,048,738.60	358,468,838.78	2,500,517,577.38
基金赎回款	-1,089,701,717.32	-174,795,152.75	-1,264,496,870.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,197,265,480.32	220,417,482.63	1,417,682,962.95

## 6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
活期存款利息收入	1,061,691.49
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,525,565.66
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	2,587,257.15

## 6.4.7.9 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出股票成交总额	1,507,950,187.16
减：卖出股票成本总额	1,387,260,328.98
减：交易费用	7,249,108.88
买卖股票差价收入	113,440,749.30

## 6.4.7.10 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

## 6.4.7.11 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

## 6.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	104,212,262.94
基金投资产生的股利收益	-
合计	104,212,262.94

## 6.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	130,927,980.18
——股票投资	130,927,980.18
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-

——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	130,927,980.18

#### 6.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
基金赎回费收入	5,137,250.12
转换费收入	2,533.25
合计	5,139,783.37

#### 6.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
合计	109,095.94

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
中泰证券（上海）资产管理有限公司（以下简称“中泰资管”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中泰证券股份有限公司（以下简称“中泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
宁波银行股份有限公司（以下简称“宁波银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中泰证券	7,017,820,553.88	100.00%	325,268,843.87	100.00%

**6.4.10.1.2 权证交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交	成交金额	占当期债券回购成交

		总额的 比例		总额的 比例
中泰证券	12,685,700,000.00	100.00%	2,362,100,000.00	100.00%

#### 6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
中泰证券	5,126,650.72	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
中泰证券	242,322.56	100.00%	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 管理人从关联方获得的服务包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究服务。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至202 2年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至202 1年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	33,345,990.80	3,574,405.10
其中：支付销售机构的客户维护费	8,964,080.51	637,717.53

注：支付基金管理人中泰资管的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值X1.50%/当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022 年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,223,066.06	238,293.71

注：支付基金托管人宁波银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值X0.10%/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中泰星元灵活配置混合A	中泰星元灵活配置混合C	合计
中泰证券 (上海)资 产管理有 限公司	0.00	1,137,143.91	1,137,143.91
中泰证券 股份有限 公司	0.00	15,508.88	15,508.88
宁波银行 股份有限 公司	0.00	266.29	266.29
合计	-	1,152,919.08	1,152,919.08

注：支付基金销售机构的C类基金份额销售服务费按前一日C类基金资产净值0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给中泰证券（上海）资产管理有限公司，再

由中泰证券（上海）资产管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日C类基金资产净值} \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期基金管理人未持有本基金。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期其他关联方未持有本基金。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
宁波银行	110,879,170.80	1,061,691.49	8,218,789.55	108,444.01
中泰证券	684,620,739.31	1,525,565.66	27,452,671.20	174,902.48

注：本基金的银行存款由基金托管人宁波银行保管，按银行同业利率计息。本基金的其他存款由基金结算机构中泰证券保管，按协议约定利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
中泰证券	688662.SH	富信科技	首次公开发行	2,556	39,899.16

中泰证券	688663.SH	新风光	首次公开发行	3,279	47,479.92
中泰证券	688383.SH	新益昌	首次公开发行	2,701	52,885.58
中泰证券	605296.SH	神农集团	首次公开发行	569	31,909.52
中泰证券	300996.SZ	普联软件	首次公开发行	2,410	50,152.10

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2022年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688349	三一重能	2022-06-15	6个月	科创板打新限售	29.80	36.94	32,650	972,970.00	1,206,091.00	-
688400	凌云光	2022-06-27	7个交易日	新股未上市	21.93	21.93	13,111	287,524.23	287,524.23	-
301139	元道通信	2022-06-30	6个交易日	新股未上市	38.46	38.46	5,085	195,569.10	195,569.10	-
301239	普瑞眼科	2022-06-22	9个交易日	新股未上市	33.65	33.65	5,172	174,037.80	174,037.80	-
301136	招标股份	2021-12-31	6个月	创业板打新限售	10.52	19.74	7,172	75,449.44	141,575.28	-
688237	超卓航科	2022-06-24	5个交易日	新股未上市	41.27	41.27	2,891	119,311.57	119,311.57	-
688225	亚信安全	2022-01-26	6个月	科创板打新限售	30.51	21.00	2,848	86,892.48	59,808.00	-



				售						
301233	盛帮股份	2022-06-24	8个交易日	新股未上市	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-
301238	瑞泰新材	2022-06-10	6个月	创业板打新限售	19.18	32.07	1,547	29,671.46	49,612.29	-
301215	中汽股份	2022-02-28	6个月	创业板打新限售	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77	-
301302	华如科技	2022-06-16	6个月	创业板打新限售	52.03	56.42	466	24,245.98	26,291.72	-
301139	元道通信	2022-06-30	6个月	创业板打新限售	38.46	38.46	566	21,768.36	21,768.36	-
301263	泰恩康	2022-03-22	6个月	创业板打新限售	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16	-
301217	铜冠铜箔	2022-01-20	6个月	创业板打新限售	17.27	14.83	1,371	23,677.17	20,331.93	-
301102	兆讯传媒	2022-03-15	6个月	创业板打新限售	39.88	31.09	642	25,602.96	19,959.78	-
301239	普瑞眼科	2022-06-22	6个月	创业板打新限售	33.65	33.65	575	19,348.75	19,348.75	-
301256	华融化学	2022-03-14	6个月	创业板打新限售	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48	-
301112	信邦智能	2022-06-20	6个月	创业板打新限售	27.53	45.04	399	10,984.47	17,970.96	-
301200	大族数控	2022-02-18	6个月	创业板打新限售	76.56	51.92	343	26,260.08	17,808.56	-
301153	中科江南	2022-05-10	6个月	创业板打新限售	33.68	43.98	398	13,404.64	17,504.04	-
301123	奕东电子	2022-01-14	6个月	创业板打新限售	37.23	25.39	656	24,422.88	16,655.84	-
301103	何氏眼科	2022-03-14	6个月	创业板打新限售	32.69	32.02	507	16,575.00	16,234.14	-

				售						
301120	新特电气	2022-04-11	6个月	创业板打新限售	13.73	15.49	1,032	14,169.36	15,985.68	-
301286	侨源股份	2022-06-06	6个月	创业板打新限售	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36	-
301151	冠龙节能	2022-03-30	6个月	创业板打新限售	30.82	21.46	703	21,666.46	15,086.38	-
301298	东利机械	2022-05-27	6个月	创业板打新限售	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22	-
301258	富士莱	2022-03-21	6个月	创业板打新限售	48.30	41.68	295	14,248.50	12,295.60	-
301220	亚香股份	2022-06-15	6个月	创业板打新限售	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75	-
301237	和顺科技	2022-03-16	6个月	创业板打新限售	56.69	41.86	261	14,796.09	10,925.46	-
301137	哈焊华通	2022-03-14	6个月	创业板打新限售	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56	-
301196	唯科技	2022-01-04	6个月	创业板打新限售	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	-
301222	浙江恒威	2022-03-02	6个月	创业板打新限售	33.98	28.96	332	11,281.36	9,614.72	-
301207	华兰疫苗	2022-02-10	6个月	创业板打新限售	56.88	56.42	168	9,555.84	9,478.56	-
301288	清研环境	2022-04-14	6个月	创业板打新限售	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96	-
301125	腾亚精工	2022-05-27	6个月	创业板打新限售	22.49	27.42	327	7,354.23	8,966.34	-
301130	西点药业	2022-02-16	6个月	创业板打新限售	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-
301135	瑞德	2022-04	6个月	创业板	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88	-

	智能	-01		打新限售						
301110	青木股份	2022-03-04	6个月	创业板打新限售	63.10	39.85	202	12,746.20	8,049.70	-
301158	德石股份	2022-01-07	6个月	创业板打新限售	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	-
301228	实朴检测	2022-01-21	6个月	创业板打新限售	20.08	20.34	373	7,489.84	7,586.82	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	6个月	创业板打新限售	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16	-
300834	星辉环材	2022-01-06	6个月	创业板打新限售	55.57	30.03	212	11,780.84	6,366.36	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

3、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

4、本基金在持有上述受限证券期间，若获得送股配股等权益，其数量与金额也包含在上述披露的相应受限证券数据中。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理包括事前控制、事中控制和事后控制。

事前控制流程包括：投资与研究部门根据宏观经济形势、财政与货币政策趋势、行业景气度、证券市场走势，提出资产配置策略建议，构建备选库。专业投资委员会根据投资与研究部门的研究成果，确立股票池、债券库和策略库的建立和调整方案，决定本委员会下属的各项资产管理产品的资产配置策略或者交易策略；评估本委员会下属的各项资产管理产品的风险。风险控制委员会负责建立公司全面风险管理体系，对公司重大业务和管理工作的风险进行评估并对重大风险的处理方案进行审核。风险管理部根据专业投资委员会制定的投资策略和资产配置方案，协助专业投资委员会进行投资策略的风险检验，以及制定相应的投资风险控制标准。

事中控制流程包括：风险管理部根据本基金资产实际投资运作状况，实时测算各种风险指标，并监测本基金资产各项风险控制指标的变化，识别、分析和评价相关业务的风险状况，出具业务风险评估报告，提出风险预警。如在风险监测中发现异常现象或存在重大隐患时，需要立即对风险进行识别，明确风险种类并对其进行度量，测算该风险的危害程度，及时向专业投资委员会提出处理措施，控制风险程度的上升。

事后控制流程包括：在风险处理措施实施以后，风险管理部实时监控处理效果并提出阶段性总结报告，进一步提出改善整体和局部风险管理的建议。此外，对本基金资产的投资组合风险状况进行定期或不定期分析和总结，定期或不定期编写风险管理报告提交风险控制委员会和专业投资委员会及投资决策委员会。风险管理部应根据市场环境的变化对投资组合的风险进行情景分析或模拟分析，在估计可能产生重大风险隐患时，及时通报专业投资委员会和投资决策委员会，并提出降低风险的建议。当市场环境的变化导致风险控制模型的适用性降低时，风险管理部应及时对所使用的风险控制模型进行重新检验和修正，包括但不限于压力测试、敏感性分析等。

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人建立了全面风险管理体系。公司业务的风险管理体系共分四个层次：第一层次为董事会，董事会是公司风险管理的最高决策机构，风险控制委员会为董事会风险管理的专门工作机构，负责制订公司风险管理总体目标和政策，审批公司风险管理的制度、流程与指标，并对公司重大经营及决策进行风险评估并提出意见；第二层次为行政办公会，行政办公会是公司风险管理的决策监督机构，风险控制执行委员会为行政办公会风险管理的常设机构，承担日常风险管理决策职责，负责提出公司业务经

营管理过程中风险防范的指导意见、制定风险管理策略、对公司风险状况和风险管理能力进行评估、监督风控措施执行情况；第三层次为风险管理部及相关职能部门。风险管理部是公司风险管理的专职日常工作机构，在首席风险官领导下监测、评估、报告公司整体风险水平，并为业务决策提供风险管理建议，协助、指导和检查各部门的风险管理工作；第四层次为各业务部门的一线风险管理。各业务部门承担一线的风控职能，执行具体的风险管理制度，并承担风险管理有效性的直接责任。公司建立了完善的内部控制制度，交易部门、投资管理部门以及风险管理部门互相独立、互相制约。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要来源于金融工具的发行者或是交易对手不能履行约定义务的行为。无论是整体市场投资者的信用偏好变化，还是基金具体投资债券和上市公司的信用恶化，都会对本基金的回报带来负面影响。另外，信用评级调整也会带来相应风险。当信用评级机构调低本基金所持有的债券的信用级别时，债券的价格会下跌，从而导致本基金的收益下降。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人处，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了证券及交易对手库管理办法，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化组合投资以分散信用风险；管理人实行交易对手白名单制度，并根据交易对手的资信状况分别限定交易额度。

于本报告期末，本基金无债券投资。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险包括两类。一是指在市场中的投资操作由于市场的深度限制或由于市场剧烈波动而导致投资交易无法实现或不能以当前合理的价格实现，从而可能为基金带来投资损失的风险。二是指开放式基金由于申购赎回要求可能导致流动资金不足的风险。

基金管理人将密切关注各类资产及投资标的的交易活跃程度与价格的连续性情况，评估各类资产及投资标的占基金资产的比例并进行动态调整，以满足基金运作过程中的流动性要求，应对流动性风险。

本报告期末，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。同时，对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于本报告期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于本报告期末，本基金确认的净赎回申请未超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年06 月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>							
银行存款	795,499,910.11	-	-	-	-	-	795,499,910.11
交易性金融资产	-	-	-	-	-	5,366,963,582.19	5,366,963,582.19
应收申购款	-	-	-	-	-	35,285,680.51	35,285,680.51
资产总计	795,499,910.11	-	-	-	-	5,402,249,262.70	6,197,749,172.81
<b>负债</b>							
应付赎回款	-	-	-	-	-	90,566,375.06	90,566,375.06
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	7,965,992.64	7,965,992.64
应付托管费	-	-	-	-	-	531,066.17	531,066.17
应付销售服务费	-	-	-	-	-	914,900.31	914,900.31
其他负债	-	-	-	-	-	424,609.98	424,609.98
负债总计	-	-	-	-	-	100,402,944.16	100,402,944.16
利率敏感度缺口	795,499,910.11	-	-	-	-	5,301,846,318.54	6,097,346,228.65
上年度末 2021年12 月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>							
银行存款	106,255,541.95	-	-	-	-	-	106,255,541.95
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,099,580,996.83	1,099,580,996.83
买入返售金融资产	180,100,450.25	-	-	-	-	-	180,100,450.25
应收利息	-	-	-	-	-	-35,068.81	-35,068.81
应收申购款	-	-	-	-	-	3,524,045.98	3,524,045.98

资产总计	286,355,992.20	-	-	-	-	1,103,069,974.00	1,389,425,966.20
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,956,680.07	1,956,680.07
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,591,286.21	1,591,286.21
应付托管费	-	-	-	-	-	106,085.75	106,085.75
应付销售服务费	-	-	-	-	-	37,484.73	37,484.73
应交税费	-	-	-	-	-	7,318.07	7,318.07
其他负债	-	-	-	-	-	301,461.76	301,461.76
负债总计	-	-	-	-	-	4,000,316.59	4,000,316.59
利率敏感度缺口	286,355,992.20	-	-	-	-	1,099,069,657.41	1,385,425,649.61

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末，本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于证券市场的整体波动，以及单个证券发行主体的自身经营情况或特殊事件影响。

基金管理人主要采取自下而上的选股策略，通过财务数据的定量分析筛选可选标的以提升选股效率，再通过对企业核心竞争力、竞争格局、竞争优势、盈利模式等定性分析精选个股，深入研究、多方验证、持续跟踪，力争在控制风险的前提下获得可观收益。本基金投资股票时，根据市场整体估值水平评估系统性风险，根据个股估值水平（中证800指数的市净率P/B）决定股票资产的投资比例。

本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的0%-95%；本基金保持不低于基金资产净值的5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。此外，本基金的管理人通过风险敞口指标、风险价值指标、敏感性分析指标、集中度指标、压力测试指标、情景分析指标等方法进行市场风险度量、跟踪和控制。



## 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	5,366,963,582.19	88.02	1,099,580,996.83	79.37
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	5,366,963,582.19	88.02	1,099,580,996.83	79.37

## 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、假设基金的市场价格风险主要源于系统性风险，公司采用beta系数来衡量股票投资的系统性风险，股票基准值为沪深300指数； 2、假设除比较基准变动外，影响基金资产净值的其他价格风险变量保持不变； 3、假设比较基准变动5%，采用线性回归法分析，因而业绩比较基准的变化对基金的净值影响线性相关。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日

	比较基准上升5%	210,807,469.21	31,596,024.73
	比较基准下降5%	-210,807,469.21	-31,596,024.73

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	5,364,201,311.72	1,096,512,941.76
第二层次	882,995.33	380,229.35
第三层次	1,879,275.14	2,687,825.72
合计	5,366,963,582.19	1,099,580,996.83

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2021年12月31日：同）。

###### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	5,366,963,582.19	86.60
	其中：股票	5,366,963,582.19	86.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	795,499,910.11	12.84
8	其他各项资产	35,285,680.51	0.57
9	合计	6,197,749,172.81	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	228,011,327.10	3.74

C	制造业	2,679,801,539.05	43.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	602,989,175.60	9.89
F	批发和零售业	798,278,523.03	13.09
G	交通运输、仓储和邮政业	144,537,023.16	2.37
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	68,897,514.92	1.13
J	金融业	391,799,564.59	6.43
K	房地产业	452,213,251.50	7.42
L	租赁和商务服务业	19,959.78	0.00
M	科学研究和技术服务业	189,506.77	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	8,277.64	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	209,620.69	0.00
R	文化、体育和娱乐业	8,298.36	0.00
S	综合	-	-
	合计	5,366,963,582.19	88.02

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601668	中国建筑	113,343,830	602,989,175.60	9.89
2	002078	太阳纸业	48,103,431	592,153,235.61	9.71
3	000002	万科A	22,059,183	452,213,251.50	7.42
4	600153	建发股份	27,446,069	358,720,121.83	5.88

5	600585	海螺水泥	9,196,736	324,460,846.08	5.32
6	002032	苏泊尔	5,689,830	320,565,022.20	5.26
7	601607	上海医药	14,184,001	256,446,738.08	4.21
8	600426	华鲁恒升	8,246,253	240,790,587.60	3.95
9	601088	中国神华	6,847,187	228,011,327.10	3.74
10	600352	浙江龙盛	22,083,462	224,809,643.16	3.69
11	601398	工商银行	41,905,227	199,887,932.79	3.28
12	600036	招商银行	4,547,669	191,911,631.80	3.15
13	603639	海利尔	9,129,302	190,345,946.70	3.12
14	000501	武商集团	16,493,720	183,080,292.00	3.00
15	603558	健盛集团	14,864,546	181,644,752.12	2.98
16	000333	美的集团	2,805,504	169,424,386.56	2.78
17	600486	扬农化工	1,162,349	154,917,874.72	2.54
18	601111	中国国航	12,449,356	144,537,023.16	2.37
19	600176	中国巨石	8,284,054	144,225,380.14	2.37
20	600309	万华化学	1,375,063	133,367,360.37	2.19
21	603444	吉比特	176,723	68,568,524.00	1.12
22	688349	三一重能	32,650	1,206,091.00	0.02
23	688567	孚能科技	14,138	401,660.58	0.01
24	688538	和辉光电	142,634	382,259.12	0.01
25	688400	凌云光	13,111	287,524.23	0.00
26	688776	国光电气	1,447	245,975.53	0.00
27	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.00
28	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.00
29	301136	招标股份	7,172	141,575.28	0.00
30	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.00
31	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.00
32	688225	亚信安全	2,848	59,808.00	0.00
33	301238	瑞泰新材	1,547	49,612.29	0.00
34	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
35	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.00

36	301302	华如科技	466	26,291.72	0.00
37	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
38	301217	铜冠铜箔	1,371	20,331.93	0.00
39	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00
40	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
41	301112	信邦智能	399	17,970.96	0.00
42	301200	大族数控	343	17,808.56	0.00
43	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
44	301123	奕东电子	656	16,655.84	0.00
45	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
46	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
47	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00
48	301151	冠龙节能	703	15,086.38	0.00
49	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
50	301258	富士莱	295	12,295.60	0.00
51	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
52	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
53	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
54	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
55	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
56	301046	能辉科技	290	10,036.90	0.00
57	301015	百洋医药	462	9,969.96	0.00
58	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
59	301207	华兰疫苗	168	9,478.56	0.00
60	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
61	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
62	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
63	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
64	301052	果麦文化	252	8,298.36	0.00
65	300614	百川畅银	329	8,277.64	0.00
66	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00

67	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
68	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
69	300834	星辉环材	212	6,366.36	0.00
70	300991	创益通	406	5,838.28	0.00
71	301010	晶雪节能	218	5,526.30	0.00
72	300992	泰福泵业	200	4,262.00	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002078	太阳纸业	602,737,596.04	43.51
2	601668	中国建筑	593,698,816.91	42.85
3	000002	万科A	470,363,684.04	33.95
4	002032	苏泊尔	341,429,962.67	24.64
5	600585	海螺水泥	339,493,093.48	24.50
6	601607	上海医药	306,043,510.89	22.09
7	600153	建发股份	301,509,690.42	21.76
8	600352	浙江龙盛	260,850,007.27	18.83
9	600036	招商银行	241,610,607.54	17.44
10	601088	中国神华	238,114,205.85	17.19
11	600426	华鲁恒升	234,402,094.49	16.92
12	601398	工商银行	227,312,297.14	16.41
13	000333	美的集团	205,693,555.10	14.85
14	603639	海利尔	196,632,228.00	14.19
15	600486	扬农化工	186,613,771.01	13.47
16	600176	中国巨石	166,645,248.11	12.03
17	600309	万华化学	158,335,685.94	11.43
18	601111	中国国航	142,616,681.05	10.29
19	603558	健盛集团	133,647,752.00	9.65

20	000501	武商集团	107,517,597.00	7.76
21	603444	吉比特	51,091,274.77	3.69

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601088	中国神华	164,620,148.86	11.88
2	002078	太阳纸业	164,218,746.48	11.85
3	600153	建发股份	151,636,479.87	10.95
4	000002	万科A	122,334,656.58	8.83
5	601668	中国建筑	118,368,385.09	8.54
6	601607	上海医药	94,090,899.64	6.79
7	600486	扬农化工	92,587,719.04	6.68
8	002032	苏泊尔	82,505,455.66	5.96
9	601111	中国国航	72,852,390.20	5.26
10	600352	浙江龙盛	61,649,969.68	4.45
11	600309	万华化学	54,652,755.00	3.94
12	600176	中国巨石	54,487,155.12	3.93
13	600036	招商银行	53,748,459.40	3.88
14	000333	美的集团	44,370,970.56	3.20
15	600585	海螺水泥	35,347,323.00	2.55
16	603639	海利尔	34,937,495.76	2.52
17	601398	工商银行	25,254,031.00	1.82
18	600761	安徽合力	25,090,891.79	1.81
19	600426	华鲁恒升	18,291,966.94	1.32
20	603589	口子窖	14,795,562.90	1.07

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元



买入股票成本（成交）总额	5,523,714,934.16
卖出股票收入（成交）总额	1,507,950,187.16

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

##### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

#### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	35,285,680.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,285,680.51

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中泰星元灵活配置	385,534	3,881.29	635,396,849.52	42.46%	860,973,385.60	57.54%

混合A						
中泰星元 灵活配置 混合C	199,931	4,799.96	751,357,178.43	78.29%	208,302,890.88	21.71%
合计	585,465	4,195.01	1,386,754,027.95	56.46%	1,069,276,276.48	43.54%

注：本表列示“占总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例；对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	中泰星元灵活配 置混合A	8,795,484.64	0.588%
	中泰星元灵活配 置混合C	15,880.16	0.002%
	合计	8,811,364.80	0.359%

注：本表列示“占基金总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例；对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区 间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资 和研究部门负责人持有本开放式 基金	中泰星元灵活配置 混合A	>100
	中泰星元灵活配置 混合C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基 金	中泰星元灵活配置 混合A	>100
	中泰星元灵活配置 混合C	0
	合计	>100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	中泰星元灵活配置混合 A	中泰星元灵活配置混合 C
基金合同生效日(2018年12月05日)基金份额总额	956,804,364.70	-
本报告期期初基金份额总额	541,751,532.74	57,352,330.32
本报告期基金总申购份额	1,377,637,145.11	1,805,652,468.94
减：本报告期基金总赎回份额	423,018,442.73	903,344,729.95
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,496,370,235.12	959,660,069.31

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未改聘为基金审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中泰证券	2	7,017,820,553.88	100.00%	5,126,650.72	100.00%	-

注：本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中泰证券	-	-	12,685,700,000.00	100.00%	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金新增日照银行股份有限公司为销售机构的公告	上海证券报、中国证监会规定网站	2022-01-07
2	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于调整旗下部分基金网上直销最低认/申购金额的公告	上海证券报、中国证监会规定网站	2022-01-10
3	关于中泰证券（上海）资产管理有限公司旗下部分证券投资基金开展直销渠道申购费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证监会规定网站	2022-01-14
4	中泰星元价值优选灵活配置混合型证券投资基金2021年	中国证监会规定网站	2022-01-20

	第4季度报告		
5	关于中泰星元价值优选灵活配置混合型证券投资基金新增招商银行股份有限公司招赢通平台为销售渠道并参加费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证监会规定网站	2022-02-15
6	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金新增华夏财富投资管理有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证监会规定网站	2022-02-24
7	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金新增国金证券股份有限公司为销售机构公告	上海证券报、中国证监会规定网站	2022-03-11
8	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金新增上海利得基金销售有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证监会规定网站	2022-03-17
9	中泰星元价值优选灵活配置混合型证券投资基金2021年年度报告	中国证监会规定网站	2022-03-30
10	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金新增上海长量基金销售有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证监会规定网站	2022-03-31
11	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金新增嘉实财富管理有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证监会规定网站	2022-04-19
12	中泰星元价值优选灵活配置	中国证监会规定网站	2022-04-21

	混合型证券投资基金2022年第1季度报告		
13	中泰星元价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定网站	2022-05-18
14	中泰星元价值优选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）2022年第1号	中国证监会规定网站	2022-05-18
15	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金新增泰信财富基金销售有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证监会规定网站	2022-05-20
16	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金新增国联证券股份有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证监会规定网站	2022-05-20
17	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金新增泛华普益基金销售有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证监会规定网站	2022-05-23
18	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金新增中国中金财富证券有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证监会规定网站	2022-06-07
19	关于中泰星元价值优选灵活配置混合型证券投资基金新增东方证券股份有限公司为销售机构的公告	上海证券报、中国证监会规定网站	2022-06-09
20	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金	上海证券报、中国证监会规定网站	2022-06-13

	新增华宝证券股份有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告		
21	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金新增北京创金启富基金销售有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证监会规定网站	2022-06-17
22	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金新增青岛银行股份有限公司为销售机构公告	上海证券报、中国证监会规定网站	2022-06-17
23	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金新增平安证券股份有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证监会规定网站	2022-06-21
24	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔最低认/申购金额、单笔最低赎回份额和最低持有份额数额限制的公告	上海证券报、中国证监会规定网站	2022-06-29

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中泰星元价值优选灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《中泰星元价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中泰星元价值优选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《中泰星元价值优选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 6、报告期内中泰星元价值优选灵活配置混合型证券投资基金在规定报刊上各项公告的原稿；
- 7、中国证监会要求的其他文件。



## 11.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人的办公场所，部分文件同时登载于基金管理人网站。

## 11.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

客户服务中心电话：400-821-0808

网站：<https://www.ztzqzg.com/>

中泰证券（上海）资产管理有限公司  
二〇二二年八月三十日